

前海再保险股份有限公司股权投资管理能力(间接股权投资)建设及自评估情况
(年度披露-【20250124】)

一、风险责任人

风险责任人	姓名	职务	风险责任人基本信息
行政责任人	周云福	代为履行公司董事长及法定代表人职责的董事	前海再保险股份有限公司关于股权投资业务风险责任人的基本信息披露公告.pdf
专业责任人	李蒙	副总经理、首席投资官	前海再保险股份有限公司关于股权投资业务风险责任人的基本信息披露公告.pdf

二、组织架构

整体评估情况
公司已按照“保险机构股权投资管理能力标准”建立了职责明确、分工合理的股权投资组织架构：公司保险资金运用实行董事会负责制，公司董事会根据监管规定及公司章程对资产配置和投资政策、风险控制、合规管理承担最终责任。董事会下设各专业委员会作为公司董事会的辅助决策机构。公司党委对重大经营管理事项进行前置研究讨论，再根据职权决策。有权决策机构作出决定。首席投资官全面负责公司的资金运用业务，指导与监督投资管理部开展投资工作。公司设置专门的投资管理部，在投资管理部负责人的管理下，执行公司资产配置、委托投资、投资研究、投资交易、绩效考核、风险管理、数据统计及监管报送等日常资金运用工作。投资管理部设置股权投资团队，负责股权投资相关的项目筛选、行业研究、尽职调查、投资交易、投后管理及项目退出等执行工作。公司已下发正式文件设立股权投资团队，并在发文中明确了该团队的职责、各岗位职责、团队负责人及人员配置等内容。综上，经自评估，我公司满足“保险机构股权投资管理能力标准”中关于股权投资组织架构的相关要求。

资产管理部门设置		
部门名称		投资管理部
股权投资部门 (团队)	发文时间	2021-09-22
	发文文号	前海再发〔2020〕196号、前海再发〔2021〕95号、前海再发〔2021〕125号、前海再发〔2021〕120号、前海再发〔2021〕146号、前海再发〔2021〕192号
	文件名称	关于投资管理部股权投资团队设置的通知、关于齐琼调岗的通知(1)、关于齐琼调岗的通知(2)、关于程刚调岗的通知、关于陈明等职务任免的决定、关于李瀚瀛等职务任免的决定
	岗位设置	股权投资团队负责人、股权投资岗、投后管理岗

三、专业队伍

整体评估情况

公司已按照“保险机构股权投资管理能力标准”组建了专业的股权投资团队，目前配备有开展间接股权投资所需要的专业人员3名，其中具有3年以上股权投资相关经验的专职投资人员2名，具有3年以上股权投资相关经验的专职投后管理人员1名。综上，经自评估，我公司股权投资业务专业队伍满足“保险机构股权投资管理能力标准”中关于开展间接股权投资所需专业队伍的相关要求。

专业队伍人员基本信息

资产管理部门当前拥有3名具有3年以上股权投资相关经验的专职人员，其中专职投后管理的人员1名

序号	姓名	岗位	相关经验类型	经验年限(年)	是否兼职
1	李瀚瀛	股权投资团队负责人	股权投资相关经验	15	否
2	王柱锋	股权投后管理经理	股权投资相关经验	6	否
3	可宗嘉	股权投资经理	股权投资相关经验	10	否

专业队伍人员管理模式	
股权投资人员管理模式	自行开展间接股权投资

四、基本制度

整体评估情况
公司已制定较完善的股权业务和风险控制制度，涵盖了授权机制、投资决策、投资操作、风险预算和全程管控、资产估值、激励约束和责任追究、信息披露和关联交易、后续管理和退出安排、应急处置和危机解决等内容，相关制度已分别经公司董事会或高级管理层批准，并以公司正式文件形式下发执行；公司亦建立了资产托管机制，确保资产运作规范透明。综上，经自评估，我公司股权投资制度建设满足“保险机构股权投资管理能力标准”中关于投资基本制度的相关要求。

股权投资基本制度	
授权机制	
制度明细一	
文件名称	前海再保险股份有限公司保险资金运用管理办法
发文文号	前海再制度〔2019〕7号
发文时间	2019-01-23
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度〔2022〕9号
发文时间	2022-03-29
评估结果	符合规定
投资决策	
制度明细一	
文件名称	前海再保险股份有限公司投资决策管理办法
发文文号	前海再制度〔2019〕8号

发文时间	2019-01-23
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司党委会议事规则
发文文号	前海再制度〔2023〕15号
发文时间	2023-05-29
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	前海再保险股份有限公司资产配置管理办法
发文文号	前海再制度〔2022〕28号
发文时间	2022-09-01
评估结果	符合规定
投资操作	
制度明细	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度〔2022〕9号
发文时间	2022-03-29
评估结果	符合规定
风险预算和全程管控	
制度明细一	
文件名称	前海再保险股份有限公司全面风险管理办法
发文文号	前海再制度〔2023〕4号
发文时间	2023-10-07
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司全面风险管理实施细则
发文文号	前海再制度〔2024〕12号
发文时间	2024-08-12
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	前海再保险股份有限公司突发事件应对管理办法
发文文号	前海再制度〔2022〕2号
发文时间	2022-01-10
评估结果	符合规定
制度明细四	
文件名称	前海再保险股份有限公司资金运用业务风险监控管理 细则
发文文号	前海再制度〔2022〕26号
发文时间	2022-09-01
评估结果	符合规定
制度明细五	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度〔2022〕9号
发文时间	2022-03-29
评估结果	符合规定

制度明细六	
文件名称	前海再保险股份有限公司资产风险五级分类管理办法
发文文号	前海再制度〔2019〕19号
发文时间	2019-07-23
评估结果	符合规定
资产估值	
制度明细	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度〔2022〕9号
发文时间	2022-03-29
评估结果	符合规定
激励约束和责任追究	
制度明细一	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资绩效考核与激励管理办法
发文文号	前海再制度〔2020〕15号
发文时间	2020-12-30
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司员工违规行为处理办法
发文文号	前海再制度〔2021〕47号
发文时间	2021-12-28
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	前海再保险股份有限公司投资行为规范
发文文号	前海再制度〔2022〕29号
发文时间	2022-09-05
评估结果	符合规定
信息披露和关联交易	
制度明细一	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度〔2022〕9号
发文时间	2022-03-29
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司信息披露管理办法
发文文号	前海再制度〔2023〕20号
发文时间	2023-12-29
评估结果	符合规定
制度明细三	
文件名称	前海再保险股份有限公司关联交易管理办法
发文文号	前海再制度〔2022〕14号
发文时间	2022-05-06
评估结果	符合规定
制度明细四	

文件名称	前海再保险股份有限公司关联交易管理实施细则
发文文号	前海再制度〔2023〕7号
发文时间	2023-10-13
评估结果	符合规定
后续管理和退出安排	
制度明细	
文件名称	前海再保险股份有限公司股权投资管理办法
发文文号	前海再制度〔2022〕9号
发文时间	2022-03-29
评估结果	符合规定
应急处置和危机解决	
制度明细一	
文件名称	前海再保险股份有限公司突发事件应对管理办法
发文文号	前海再制度〔2022〕2号
发文时间	2022-01-10
评估结果	符合规定
制度明细二	
文件名称	前海再保险股份有限公司资金运用业务风险监控管理细则
发文文号	前海再制度〔2022〕26号
发文时间	2022-09-01
评估结果	符合规定
资产托管机制	
制度明细	
文件名称	前海再保险股份有限公司保险资产托管管理办法
发文文号	前海再制度〔2018〕11号
发文时间	2018-06-22
评估结果	符合规定

五、管理能力

整体评估情况

公司采取间接股权投资的方式开展股权投资业务；以分散投资风险、保障投资资产安全性、收益性为目标，在服务主业的同时增强业务协同和战略资源支持能力，进一步提升公司的市场竞争力和为保险公司客户的服务效果及效率。公司通过加强投资研究及项目资源储备，积极寻求和把握优质的间接股权投资机会。公司具备较完善的公司治理、管理制度、决策流程和内控机制。公司通过规范的事前审批决策、事中监控及投后管理和评价工作对股权投资业务进行严格管控。公司建立了资产托管机制，资产运作规范透明。公司建立了一支覆盖投研、风控及投后管理为核心能力的专业队伍，并持续加强行业研究及投资业务能力的建设。公司近三年未发生重大违法违规行为。综上，经自评估，我公司股权投资管理能力满足“保险机构股权投资管理能力标准”中关于开展间接股权投资的相关要求。

六、风险控制体系

整体评估情况

对于事前控制：公司通过建立健全投资业务的相关制度，规范投资行为。对于中应具体流程，在开、风险、合规、法律中提供对于事中监督：公司投资风险的动态监控与评估，并定期开展评价以及追踪整改的方式，确保公司资金运用安全。另外，公司制定了《全面风险管理办法》及相关细则，规定了投资管理部对于事前、事中、事后发生的风险事件应及时报告精算与风险管理部。另外，公司建立了《兼职合规、风控人员暂行规定》，明确并规范了兼职风控人员日常工作发生的风险，应及时向精算与风险管理部、首席风险官汇报的机制及相应流程。综上所述，公司建立了资金运用“三道防线”的立体管理模式，投资管理部为第一道防线，精算与风险管理部、法律合规部为第二道防线，审计部为第三道防线，“三道防线”各司其职、多管齐下，层层递进、交互配合，有效保障资金运用风险管控到位，力争全面防范和管理股权投资风险。

风险管理制度	公司制定了《全面风险管理》及《风险管理办法》等制度，明确了风险管理的原则、流程、组织架构、职责分工、风险识别、评估、监控、报告、应对、改进等环节，并建立了风险偏好体系、风险容忍度、风险限额、风险指标、风险预警、风险处置、风险问责等机制。公司还建立了《风险管理制度实施细则》、《风险管理制度操作规程》、《风险管理制度考核办法》等配套制度，确保风险管理制度得到有效执行。 公司通过《员工违规行为处理办法》、《投资行为规范》等制度建立了责任追究机制，对于违反规定的行为，将根据违规行为的性质、造成的损失等进行追究。公司按年度制定风险绩效考核方案并开展考核，由精算与风险管理部对公司各业务部门的风险绩效进行评估，并将评估结果纳入各业务部门的绩效考核指标中。
风险管理系统	公司配备的绩效评估与风险管理系统涵盖限额监控、组合风险、组合绩效的监测、预警与绩效评估。其中限额监控模块包括了规则库设置、监控规则设置、投资池设置等功能；组合风险模块包括了Var分析、波动率分析、Beta分析、流动性风险分析等功能；组合绩效模块包括了收益概貌、净值收益对比、风险调整收益、择机分析、Fama分解、Brinson业绩归因、主动贡献归因等功能。同时，公司具有独立的风险管理系统，涵盖风险指标管理、风险报表报告、压力测试、RCSA管理、损失事件管理、制度管理等模块，其中风险指标管理设置了关键风险及合规指标，并根据风险类别划分三档进行预警。

自评估结果及承诺

根据《关于优化保险机构投资管理能力监管有关事项的通知》及相关监管规定，我对股权投资管理能力建设进行了调研论证和自我评估，经过充分论证和评估，我达到了该项能力的基本要求，现按规定披露相关信息。

我承诺对本公告披露的及时性、内容的真实性、完整性负责。